

(上接A19版)

资产支持证券规模的10%；

12.本基金管理人应根据绝对评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券，基金持有资产支持证券期间,如果其信用级别下降,不得低于投资组合,应在评级报告发布之日起3个月内予以卖出。

13.基金财产参与或单只票面发行的基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不能超过拟发行股票的总量;

14.本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

15.本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

16.本基金若持有以定期存款方式持有的股票,应符合以下的限制:

(1)本基金在任何交易日均持有的股票,按股数折合平均价值,不得超过基金资产净值的10%。

(2)本基金在任何交易日均持有的持有的股票,按股数折合平均价值,不得超过基金资产净值的5%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券),权证,资产支持证券,买人返售资金头寸,不含质押品回购等。

(3)本基金在任何交易日均持有的卖出回购的股票,按股数折合平均价值的20%。

(4)本基金持有的股票的市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合《基金合同》对股票投资比例的有关约定;

(5)本基金在任何交易日内(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。

17.本基金持有的所有中小企业私募债,其市值不得超出该基金基金资产净值的10%;

18.本基金持有的所有证券公司短期公司债券,其市值不得超出该基金基金资产净值的10%;

19.法律法规和中国证监会规定的其他因素导致基金投资比例不符合上述规定时,基金管理人应及时调整投资组合。

因本基金所处市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定时,基金管理人应在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应公告基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此期间,基金的投资范围和投资策略应当符合基金合同的有关约定。基金管理人对基金的监督与检查在基金合同生效之日起开始。

以上限制中,如为法律法规或监管部门的强制性要求,法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人报告中国证监会。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是以服务费冲抵管理费用的除外;

(5)从事内幕交易,操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者其他与基金管理人具有重大利害关系的公司发行的证券或者从事衍生品交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循有利于保护投资者利益的原则,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格原则,经相关交易对手事先同意并签署书面协议后予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并将关联交易结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

(二)基金管理人发现基金管理人有重大违法违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将其纠正结果报告中国证监会。

基金管理人发现基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延